



Obchodné portfólio privátneho algoritmickeho hedge fondu Atlantis sa realizuje s dennou frekvenciou obchodovania na trhoch s vysokou likviditou. Cieľom fondu je poskytovať absolútnu návratnosť s miernym profilom rizika a s nízkou koreláciou. Fond dosahuje stanovené ciele vývojom, testovaním a implementáciou automatických obchodných stratégií založených na systematickom a algoritmickej obchodovaní. Portfólio zahŕňa viaceré aktíva trhu s kovmi, menovými nástrojmi, indexami a energetickými aktívami. Realizácia jednotlivých obchodov prebieha na regulovaných, centralizovaných a derivátových trhoch. Stratégie uskutočňujú dlhé a krátke pozície s cieľom profitovať z identifikovaných krátkych, stredných a sezónnych trendov a trendov plynúcich z opakujúcich sa patternov, cenových formácií. Vytvorené systémy dokážu v kritických situáciách a pri vysokej volatilitě aplikovať hedge obchodný prístup. Cieľom portfólia, ktoré je kalibrované z ~ 50 logicky odlišných obchodných systémov, je dosahovať zisk v každom mesiaci. Naše riadenie rizika je prísne, založené na jasne definovaných pravidlách dynamicky sa meniaceho portfólia, ktoré sa neustále prispôbuje trhovým podmienkam. Pre viac detailov je možné sledovať náš aktuálny výstup: <https://www.atlanticapital.fund/>

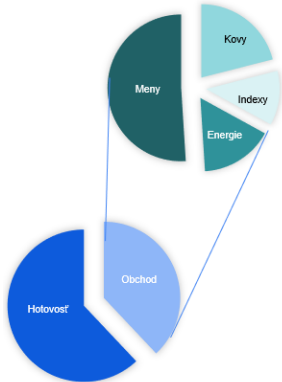
FAKTY O FONDE

Názov	Hedge Fund
Sídlo	Česká republika
Veľkosť fondu	€ 10,29MM
Mena fondu	EUR
Likvidita	Mesačne
Obdobie blokovania	Žiadne
Odporúčaná doba investovania	6+ mesiacov
High watermark	Áno
Manažment	Atlantis Capital CZ
Regulátor	ČNB, Praha
Broker	Vantage, I.B., Lmax
Správčový poplatok	0,1% monthly
Vstupný poplatok	1,75%
Success fee	25%
Výstupný poplatok	0%
Cieľ ročného výnosu	15% - 30% p.a.
Stratégia	Alghos

ŠTATISTIKY FONDU

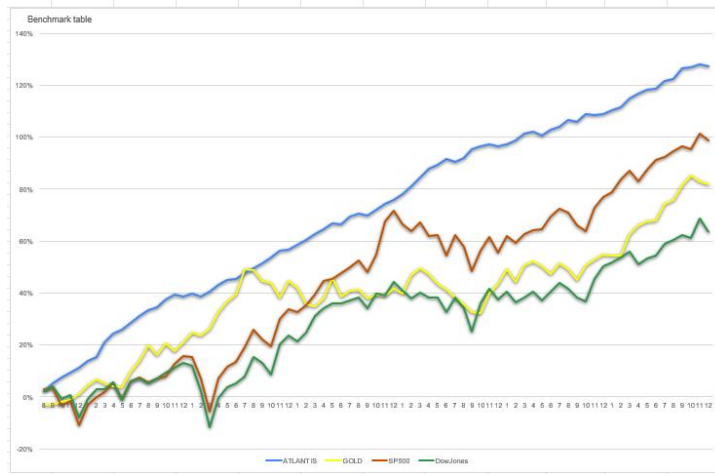
Zhodnotenie za posl. mesiac	-0,96%
Zhodnotenie od založenia fondu	127,28%
Zhodnotenie za posl. 12 mesiacov	18,22%
Počet obchodov za posl. mesiac	108
Max. drawdown from peak	3,47%
Sharpe ratio	0,81
Profit factor	0,55
Positive trades	60,3%

ALOKÁCIA VO FONDE



Naším cieľom je dlhodobou dosahovať výnosy nad trhovým priemerom a pri nízkej volatilitě portfólia.

VÝKONNOSTNÝ GRAF



LIST OBCHODNÝCH INSTRUMENTOV

INDEXES

DAX	↑
Dow Jones	↓
NASDAQ 100	↑
S&P 500	↓
EU STOXX 50	↑
FTSE 100	↓
Russel 2000	↓
Nikkei 225	↑

ENERGY

Natural Gas	↑
Brent Oil	↑
Crude Oil	↑

METALS

Platinum	↓
Gold	↓
Palladium	↓
Silver	↓

CURRENCIES

Australian dollar	↓
British pound	↓
Japanese yen	↑
Canadian dollar	↑
US dollar Index99	↑

OTHERS

Kcw CBT	-
Lean Hogs	-



KOMENTÁŘ

JUDr. Luboš Žuffa
CEO company

Privátny algoritmickej hedge fond - ATLANTIS zaznamenal za mesiac december 2024 pokles -0,96%. Pre americký dolár to bol vynikajúci začiatok roka. Americká mena sa tento rok rozbehla, podporovaná americkou ekonomickou hegemoniou. Číslo hovoria samy za seba. USA predstavujú len 4 % svetovej populácie, ale 25 % svetového HDP, 31 % svetového bohatstva domácností, 46 % celosvetových investícií do rizikového kapitálu, 65 % svetovej kapitalizácie akciového trhu a dokonca 75 % referenčného globálneho indexu: svetový index MSCI (55-ročné maximum). To všetko podporuje atraktivitu amerického dolára. Zdá sa, že tento rok bude pre eurozónu ťažký. EUR/USD sa na začiatku mesiaca dostal na dvojročné minimum a krátkodobou by mohol ďalej klesať. Pre nikoho to nie je prekvapenie. Depreciácia eura je znakom neúprosneho hospodárskeho a finančného dištancovania sa menovej únie od USA. Na druhej strane Atlantiku sa predpokladá, že rast prekročí svoj potenciál na úrovni približne 2% v roku 2025 po dosiahnutí 2,5% v roku 2024. Eurozóna tento rok porastie prinajlepšom o 1%. Toto číslo možno zrevidovať smerom nadol vzhľadom na nemeckú recesiu a francúzske politické otrasy, ktoré budú brzdiť spotrebiteľské výdavky a investície v krajine. A Európa sa tiež snaží vyniknúť z hľadiska výnosov z finančných aktív.

TRADING RESULT

Year	1.	2.	3.	4.	5.	6.	7.	8.	9.	10.	11.	12.	SUM
2018								2,26%	2,96%	2,04%	1,90%	1,93%	11,10%
2019	2,61%	1,61%	5,63%	3,57%	1,20%	2,69%	2,74%	2,33%	0,87%	3,23%	1,85%	-0,61%	27,72%
2020	0,89%	-1,19%	2,11%	2,31%	1,91%	0,54%	2,13%	1,86%	1,97%	2,28%	1,73%	1,49%	18,03%
2021	1,57%	2,14%	2,05%	1,91%	2,43%	-0,42%	3,04%	1,13%	-0,83%	2,15%	2,33%	1,63%	19,13%
2022	2,17%	3,06%	3,14%	3,40%	1,76%	2,07%	-1,14%	1,43%	3,42%	1,14%	0,64%	-0,67%	20,42%
2023	0,96%	1,25%	2,81%	0,56%	-1,18%	2,14%	1,15%	2,38%	-0,70%	3,11%	-0,36%	0,54%	12,66%
2024	1,21%	1,39%	3,08%	2,10%	1,27%	0,38%	3,02%	1,08%	4,07%	0,43%	1,15%	-0,96%	18,22%